

Sparkasse KölnBonn

Stand per 31.03.2022

Externer Report gem. § 28 PfandBG - zum Öffentlichen Pfandbriefumlauf

Stichtag	I 2022
Referenz	I 2021

I) Angaben zu Gesamtbetrag und Laufzeitstruktur

(Angaben in Mio. Euro)

§ 28 (1) Nr. 1 und 3 PfandBG Verhältnis Umlauf zur Deckungsmasse	Nennwert		Barwert		Risikobarwert inkl. Währungsstress *	
	I 2022	I 2021	I 2022	I 2021	I 2022	I 2021
Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs inkl. Derivate	36,20	36,20	38,35	40,23	37,60	38,50
Gesamtbetrag der Deckungsmassen inkl. Derivate	250,61	275,26	260,75	299,02	240,66	273,28
% Fremdwährungsderivate v. Passiva	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
% Zinsderivate v. Passiva	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
% Fremdwährungsderivate v. Aktiva	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
% Zinsderivate v. Aktiva	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Überdeckung in %	592,29%	660,38%	579,82%	643,33%	540,08%	609,81%

§ 28 (1) Nr. 2 PfandBG Laufzeitstruktur und Zinsbindungsfrist	Pfandbriefumlauf		Deckungsmasse	
	I 2022	I 2021	I 2022	I 2021
bis zu sechs Monate	20,00	-	20,51	31,84
mehr als sechs Monate bis zu zwölf Monaten	11,20	-	12,27	9,94
mehr als zwölf Monate bis zu 18 Monaten	0,00	20,00	20,99	19,02
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	0,00	11,20	5,84	11,42
mehr als 2 Jahre bis zu 3 Jahren	0,00	-	89,67	25,36
mehr als 3 Jahre bis zu 4 Jahren	5,00	-	44,04	88,62
mehr als 4 Jahre bis zu 5 Jahren	0,00	5,00	4,91	40,93
mehr als 5 Jahre bis zu 10 Jahren	0,00	-	26,92	24,47
über 10 Jahre	0,00	-	25,44	23,68

§ 28 (1) Nr. 9 PfandBG Kennzahlen	I 2022	I 2021
Anteil festverzinslicher Deckungsmasse	89,00%	90,29%
Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	100,00%	100,00%

§ 28 (1) Nr. 10 PfandBG (nach § 6 Pfandbrief-Barwertverordnung) Fremdwährung	Zinsstress-Barwert der Deckungsmassen		Zinsstress-Barwert des Pfandbriefumlaufs		Wechselkurs		Nettobarwert in Fremdwährung		Nettobarwert in EUR	
	I 2022	I 2021	I 2022	I 2021	I 2022	I 2021	I 2022	I 2021	I 2022	I 2021
	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00

* Sowohl die Ermittlung des Risikobarwerts als auch des Währungsstresses erfolgt statisch.

Sparkasse KölnBonn

Stand per 31.03.2022

Externer Report gem. § 28 PfandBG - zum Öffentlichen Pfandbriefumlauf

II) Zusammensetzung der ordentlichen Deckungswerte

(Angaben in Mio. Euro)

Verteilung der Deckungswerte Anteil am Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs (nominal)	I 2022		I 2021	
	in Mio. EUR	in %	in Mio. EUR	in %
Gesamte Deckungsmasse	250,61	692,29%	275,26	660,38%
davon Ordentliche Deckung nach § 20 (1) PfandBG	250,61	692,29%	275,26	660,38%
davon Sichernde Überdeckung nach § 4 (1) PfandBG	5,25	14,50%	5,22	12,98%
davon Weitere Deckung nach § 20 (2) PfandBG	0,00	0,00%	0,00	0,00%
davon Sichernde Überdeckung nach § 20 (2) Nr. 2 PfandBG	0,00	0,00%	0,00	0,00%

§28 (3) Nr.1 PfandBG Gesamtbetrag der verwendeten Forderungen nach Größenklassen		
	I 2022	I 2021
bis zu 10 Millionen €	53,71	47,59
mehr als 10 Millionen bis zu 100 Millionen €	196,90	227,67
mehr als 100 Millionen €	0,00	0,00

§28 (3) Nr. 2 Gesamtbetrag der verwendeten Forderungen		Staat		Regionale Gebietskörperschaft		Örtliche Gebietskörperschaft		Sonstige Schuldner		GESAMT	darin enthaltene Gewährleistungen aus Gründen der Exportförderung
		geschuldet von	gewähr- leistet von	geschuldet von	gewähr- leistet von	geschuldet von	gewähr- leistet von	geschuldet von	gewähr- leistet von		
Land	I 2022	0,25	0,00	5,00	8,58	196,57	2,49	37,72	0,00	250,61	0,00
	I 2021	0,00	0,00	5,00	6,40	230,39	0,00	33,47	0,00	275,26	0,00
DECKUNGS-WERTE, GESAMT	I 2022	0,25	0,00	5,00	8,58	196,57	2,49	37,72	0,00	250,61	0,00
	I 2021	0,00	0,00	5,00	6,40	230,39	0,00	33,47	0,00	275,26	0,00

Sparkasse KölnBonn

Stand per 31.03.2022

Externer Report gem. § 28 PfandBG - zum Öffentlichen Pfandbriefumlauf

III) Zusammensetzung der weiteren Deckungswerte

(Angaben in Mio. Euro)

§ 28 (1) Nr. 8 PfandBG Gesamtbetrag der Forderungen, die die Begrenzungen überschreiten		
	I 2022	I 2021
§20 (2) Nr. 2 PfandBG	0,00	0,00

§ 28 (1) Nr. 4 und 5 PfandBG Gesamtbetrag der eingetragenen Forderungen	Ausgleichsforderungen i.S.d. §20 (2) Nr. 1 PfandBG		Forderungen i.S.d. §20 (2) Nr. 2 PfandBG				Summe	
			Gesamt		davon gedeckte Schuldver- schreibungen i.S.d. Art. 129 Verord. (EU) Nr. 575/2013			
	Staat	I 2022	I 2021	I 2022	I 2021	I 2022	I 2021	I 2022
keine	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Summe	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00

IV) Übersicht über rückständige Leistungen

(Angaben in Mio. Euro)

§ 28 (3) Nr. 3 PfandBG Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen	Staat		Regionale Gebietskörper- schaften		Örtliche Gebietskörper- schaften		Sonstige Schuldner		Summe	
	I 2022	I 2021	I 2022	I 2021	I 2022	I 2021	I 2022	I 2021	I 2022	I 2021
keine	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Summe	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00

§ 28 (3) Nr. 3 PfandBG Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5% der Forderung beträgt	Staat		Regionale Gebietskörper- schaften		Örtliche Gebietskörper- schaften		Sonstige Schuldner		Summe	
	I 2022	I 2021	I 2022	I 2021	I 2022	I 2021	I 2022	I 2021	I 2022	I 2021
keine	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Summe	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00